



LDB
EMPRESAS

PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO
JULHO 2024



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 31.07.2024.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

89,34%

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,60	0,09	1,04	2,42	4.096.897,58	1,81	6.518.185.291,57	0,06
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,75	0,09	0,76	3,90	9.040.073,81	3,99	5.421.914.339,44	0,17
BB	BB	BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,06	0,04	0,91	6,15	19.719.525,83	8,70	31.204.215.776,09	0,06
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	2,72	0,13	0,90	2,88	30.235.723,06	13,33	456.323.889,31	6,63
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,77	0,10	0,73	3,70	9.042.002,85	3,99	4.447.571.914,17	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,73	0,09	0,89	4,13	16.264.961,35	7,17	7.242.310.243,82	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,04	0,91	5,96	81.097.158,66	35,76	11.174.050.209,03	0,73
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,33	0,08	0,96	3,35	5.177.824,27	2,28	4.733.163.653,12	0,11
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	2,62	0,07	0,88	1,65	2.541.345,44	1,12	1.916.003.713,61	0,13
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,06	0,04	0,89	6,10	8.265.321,37	3,64	7.130.754.638,24	0,12
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			0,85	0,07	0,90	5,00	185.480.834,22	81,79		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,04	0,97	6,26	7.355,87	0,00	17.211.240.215,08	0,00
BRADERSCO	BRADERSCO	BRADERSCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,10	0,05	1,00	3,12	4.640.377,79	2,05	12.128.254.135,40	0,04
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,05	0,30	2,08		5.096.332,75	2,25	1.089.610.352,93	0,47
GRAPHEN	RJI	LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1,04	0,07	0,45	0,51	4.938.636,68	2,18	76.139.419,52	6,49
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			1,26	0,14	1,18	1,83	14.682.703,09	6,47		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	RJI	INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	4,22	-0,48	-0,48	-6,41	367.607,60	0,16	5.826.507,47	6,31
GRAPHEN	RJI	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,50	-0,36	-0,36	-3,11	1.173.736,59	0,52	69.778.284,79	1,68
Sub-total Artigo 7º V, Alínea a			1,85	-0,39	-0,39	-3,91	1.541.344,19	0,68		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	GENIAL	PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,24	-0,01	-0,44	-5,84	880.607,14	0,39	19.659.202,38	4,48
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,24	-0,01	-0,44	-5,84	880.607,14	0,39		
Renda Fixa			0,86	0,07	0,90	4,75	202.585.488,64	89,34		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

6,47%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,94	1,58	2,47	-8,91	5.276.970,20	2,33	1.135.111.774,74	0,46
XP	SANTANDER	XP INVESTOR FI DE ACOES	15,05	1,21	5,17	-5,98	9.403.400,66	4,15	208.130.478,06	4,52
Sub-total Artigo 8º I			13,85	1,34	4,18	-7,05	14.680.370,86	6,47		
Renda Variável			13,85	1,34	4,18	-7,05	14.680.370,86	6,47		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,84%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,92	4,01	0,51	40,23	4.170.278,99	1,84	2.714.087.550,41	0,15
Sub-total Artigo 9º III			14,92	4,01	0,51	40,23	4.170.278,99	1,84		
Investimentos no Exterior			14,92	4,01	0,51	40,23	4.170.278,99	1,84		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

1,38%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,52	1,48	1,38	18,31	3.124.044,51	1,38	1.927.124.130,10	0,16
GRAPHEN	RJI	LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	1,78	-0,02	-0,39	-4,32	15.985,41	0,01	1.318.485,42	1,21
Sub-total Artigo 10º I			11,45	1,47	1,37	18,16	3.140.029,92	1,38		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GENIAL	RJI	GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	
Sub-total Artigo 10º II			0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00		

Investimentos Estruturados			11,45	1,47	1,37	18,16	3.140.029,92	1,38		
-----------------------------------	--	--	--------------	-------------	-------------	--------------	---------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

0,96%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	RJI	HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	5,39	0,00	0,13	-3,79	2.187.035,51	0,96	68.528.014,14	3,19
Sub-total Artigo 11º			5,39	0,00	0,13	-3,79	2.187.035,51	0,96		
Fundos Imobiliários			5,38	0,00	0,13	-3,79	2.187.035,51	0,96		
Total			1,58	0,24	1,10	4,37	226.763.203,92	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	185.480.834,22	81,79	0,00	53,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	14.682.703,09	6,47	0,00	8,00	50,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.541.344,19	0,68	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	880.607,14	0,39	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Renda Fixa	202.585.488,64	89,34					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	14.680.370,86	6,47	0,00	12,00	30,00	0,00	30,00
	Total Renda Variável	14.680.370,86	6,47					30,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	4.170.278,99	1,84	0,00	2,00	10,00	0,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	4.170.278,99	1,84					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	3.140.029,92	1,38	0,00	2,00	5,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	0,00	0,00	0,00	1,00	5,00	0,00	5,00
	Total Investimentos Estruturados	3.140.029,92	1,38					15,00
Fundos Imobiliários								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	2.187.035,51	0,96	0,00	2,00	5,00	0,00	5,00
	Total Fundos Imobiliários	2.187.035,51	0,96					5,00
Total		226.763.203,92	100,00					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,90 98,80	5,00 81,00	2,31 90,66	4,14 80,27	9,61 83,48	1.656.626,06	9.027.580,87
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,18 130,40	1,83 29,61	1,79 70,01	1,62 31,36	3,30 28,67	171.646,31	262.296,17
Artigo 7º V, Alínea a % do CDI	-0,39 -42,78	-3,91 -63,29	-1,52 -59,76	-3,17 -61,46	-6,18 -53,73	-6.005,02	-62.695,70
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,44 -48,96	-5,84 -94,55	-1,58 -62,03	-5,60 -108,63	-7,28 -63,21	-3.953,27	-56.083,37
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	4,18 1,16	-7,05 -2,19	2,10 0,73	-3,28 -3,20	2,86 -1,82	589.408,97	-1.114.161,17
Artigo 9º III % do CDI	0,51 56,00	40,23 651,34	20,99 822,91	34,11 661,13	49,78 432,51	21.077,69	1.025.058,75
Artigo 10º I % do CDI	1,37 151,01	18,16 294,14	10,60 415,80	16,23 314,66	26,32 228,70	42.432,88	482.703,12
Artigo 11º % do CDI	0,13 14,74	-3,79 -61,34	-3,95 -154,90	-3,92 -76,03	-6,42 -55,79	2.933,14	-86.242,76
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO (Total)						2.474.166,76	9.478.455,91

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	4.054.898,28	0,00	0,00	0,00	4.096.897,58	41.999,30	96.897,58
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	8.971.565,69	0,00	0,00	0,00	9.040.073,81	68.508,12	360.757,71
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	19.542.249,33	0,00	0,00	0,00	19.719.525,83	177.276,50	1.142.599,49
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	29.965.432,91	0,00	0,00	0,00	30.235.723,06	270.290,15	864.797,21
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	8.976.822,19	0,00	0,00	0,00	9.042.002,85	65.180,66	345.268,36
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	16.121.027,10	0,00	0,00	0,00	16.264.961,35	143.934,25	645.381,45
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	81.191.746,78	492.066,22	-1.366.233,58	0,00	81.097.158,66	779.579,24	4.489.258,63
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5.128.383,07	0,00	0,00	0,00	5.177.824,27	49.441,20	167.644,40
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP	2.519.237,40	0,00	0,00	0,00	2.541.345,44	22.108,04	41.345,44

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
LIMITADA							
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	8.192.075,85	0,00	0,00	0,00	8.265.321,37	73.245,52	908.567,52
	184.663.438,60	492.066,22	-1.366.233,58	0,00	185.480.834,22	1.656.626,06	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	7.285,04	0,00	0,00	0,00	7.355,87	70,83	433,58
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	4.594.639,40	0,00	0,00	0,00	4.640.377,79	45.738,39	140.377,79
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4.992.501,67	0,00	0,00	0,00	5.096.332,75	103.831,08	96.332,75
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	4.916.630,67	0,00	0,00	0,00	4.938.636,68	22.006,01	25.152,05
	14.511.056,78	0,00	0,00	0,00	14.682.703,09	171.646,31	

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	369.375,61	0,00	0,00	0,00	367.607,60	-1.768,01	-24.982,74
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1.177.973,60	0,00	0,00	0,00	1.173.736,59	-4.237,01	-37.712,96
	1.547.349,21	0,00	0,00	0,00	1.541.344,19	-6.005,02	

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
PIATÁ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	893.746,79	0,00	0,00	9.186,38	880.607,14	-3.953,27	-56.083,37
	893.746,79	0,00	0,00	9.186,38	880.607,14	-3.953,27	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	5.149.887,58	0,00	0,00	0,00	5.276.970,20	127.082,62	-516.331,00
XP INVESTOR FI DE ACOES	8.941.074,31	0,00	0,00	0,00	9.403.400,66	462.326,35	-597.830,17
	14.090.961,89	0,00	0,00	0,00	14.680.370,86	589.408,97	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4.149.201,30	0,00	0,00	0,00	4.170.278,99	21.077,69	1.025.058,75
	4.149.201,30	0,00	0,00	0,00	4.170.278,99	21.077,69	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.081.548,51	0,00	0,00	0,00	3.124.044,51	42.496,00	483.424,91
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	16.048,53	0,00	0,00	0,00	15.985,41	-63,12	-721,79
	3.097.597,04	0,00	0,00	0,00	3.140.029,92	42.432,88	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Proventos	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financ. Ano (R\$)
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	2.193.187,22	0,00	0,00	0,00	0,00	2.187.035,51	-6.151,71	-95.327,61
	2.193.187,22	0,00	0,00	0,00	0,00	2.187.035,51	2.933,14	

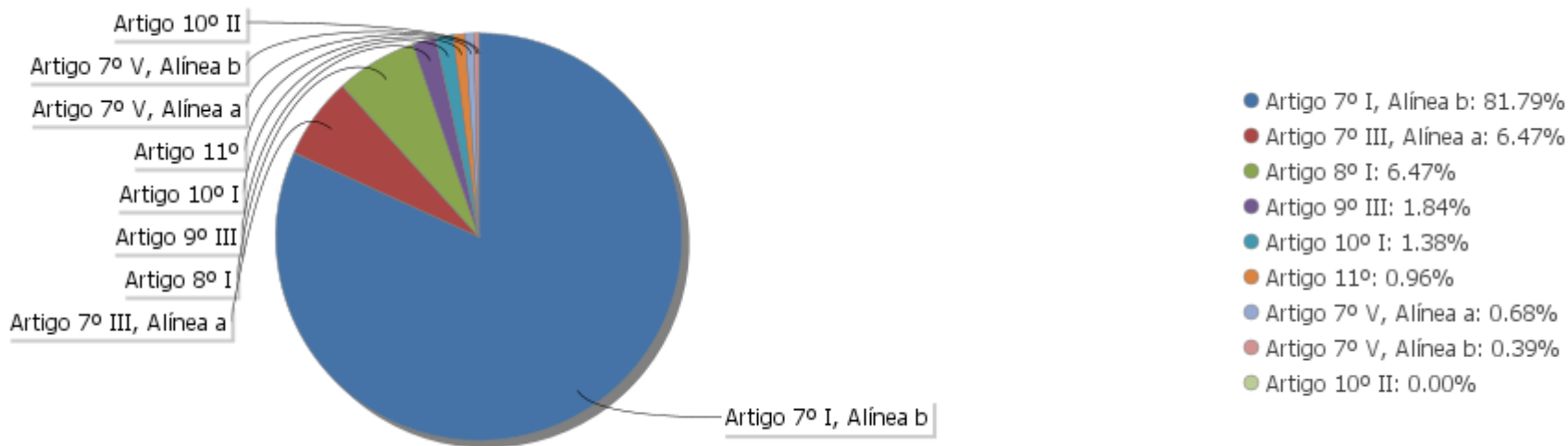
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

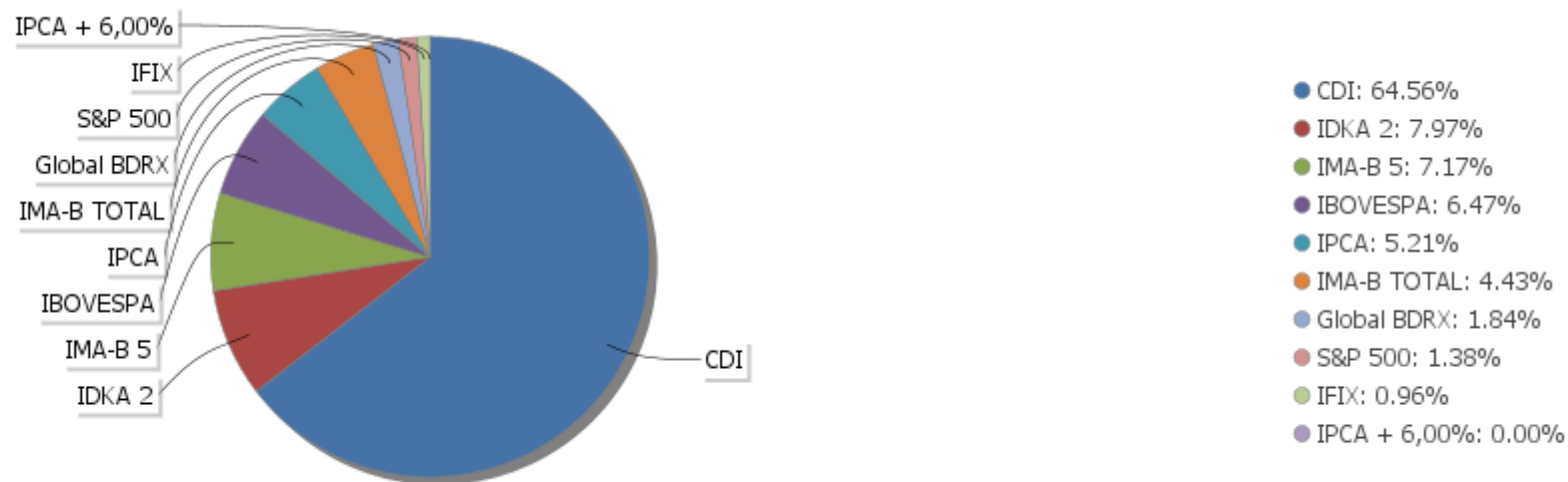
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	190.708.237,04	84,10	50,00	190.708.237,04	84,10	50,00
de 31 dias a 365 dias	0,00	0,00		190.708.237,04	84,10	50,00
acima de 365 dias	36.054.966,88	15,90		226.763.203,92	100,00	50,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

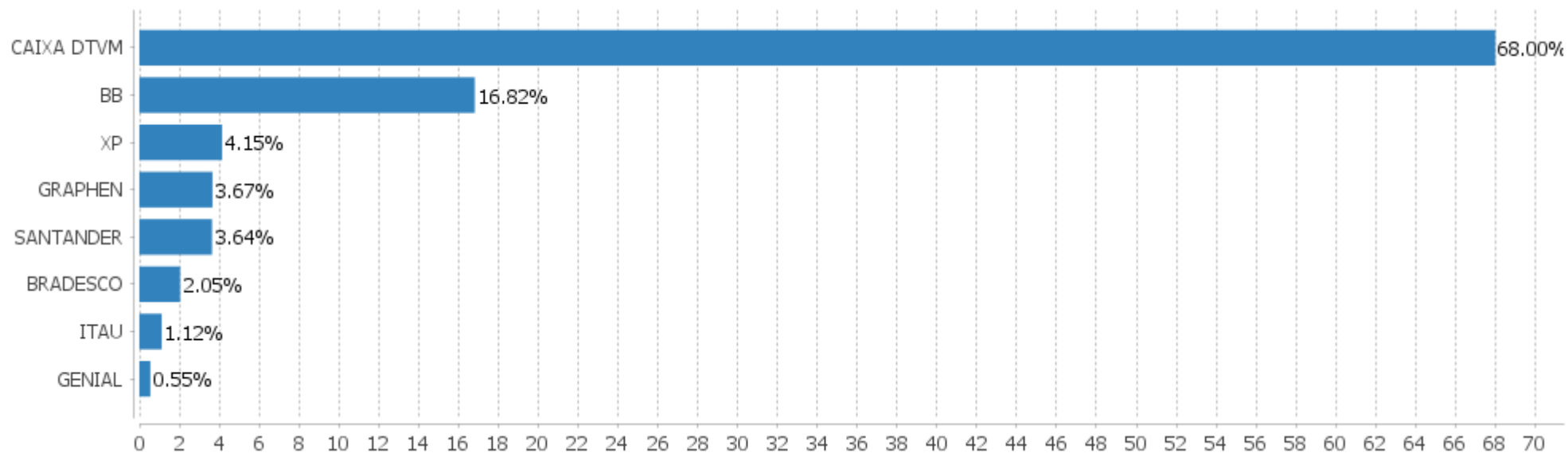


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,47	0,82	0,65	-0,18	0,72	0,72	1,10						4,37
IPCA + 4,96%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,82						5,82
p.p. indexador	-0,37	-0,38	0,11	-0,99	-0,15	0,12	0,27						-1,45
2023	1,28	-0,12	0,69	0,98	1,45	1,62	1,03	0,51	0,46	0,02	2,16	1,45	12,13
IPCA + 4,81%	0,94	1,18	1,14	0,95	0,64	0,31	0,51	0,66	0,63	0,63	0,65	0,94	9,59
p.p. indexador	0,33	-1,29	-0,46	0,03	0,81	1,30	0,52	-0,15	-0,18	-0,61	1,50	0,52	2,54
2022	0,90	0,32	2,54	-2,42	1,29	-1,90	1,12	1,70	0,58	2,21	-1,08	-0,13	5,11
IPCA + 4,84%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,10	0,97	0,79	1,04	10,88
p.p. indexador	-0,03	-1,05	0,50	-3,84	0,40	-2,97	1,41	1,63	0,48	1,24	-1,87	-1,17	-5,77
2021	-0,87	-1,11	0,42	1,13	1,62	0,49	-1,14	-1,30	-1,12	-2,34	1,30	0,98	-2,01
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-1,54	-2,35	-0,99	0,40	0,35	-0,48	-2,56	-2,64	-2,73	-4,01	-0,07	-0,24	-18,00
2020	0,22	-1,14	-7,62	-0,32	1,94	1,77	2,89	0,49	-1,40	-0,10	2,74	3,33	2,34
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,62
p.p. indexador	-0,49	-1,80	-8,19	-0,46	1,87	1,03	2,01	-0,22	-2,52	-1,44	1,40	1,48	-8,28
2019	3,17	0,13	0,33	0,93	1,68	2,27	1,00	0,16	1,69	1,80	0,46	2,27	17,05
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,34	-0,76	-0,87	-0,13	1,04	1,82	0,27	-0,46	1,25	1,17	-0,52	0,63	6,46
2018	2,72	-0,87	0,78	0,37	-2,04	-0,27	2,02	-0,90	0,55	4,00	0,72	0,93	8,16
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,92	-1,61	0,20	-0,34	-2,93	-2,02	1,18	-1,34	-0,37	3,04	0,46	0,31	-1,76

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	36	45,57
Meses abaixo - Meta Atuarial	43	54,43

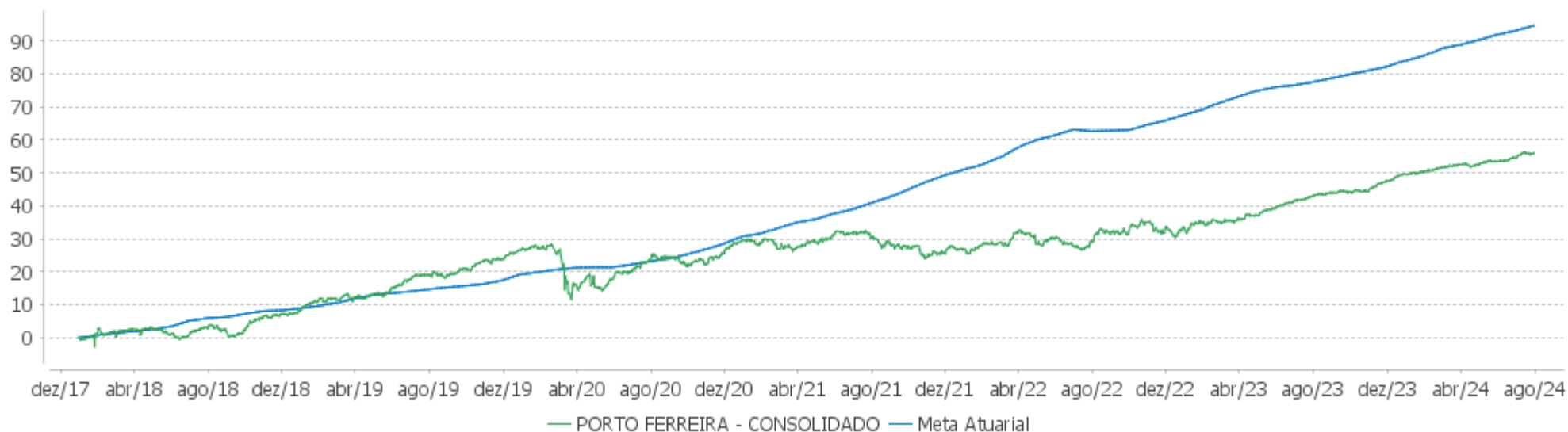
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,00	2018-10
Menor rentabilidade da Carteira	-7,62	2020-03

Relatório

Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,55	2,30	0,25	1,53
06 meses	3,88	4,93	-1,05	1,48
12 meses	9,25	9,60	-0,35	1,58
24 meses	20,87	19,45	1,42	3,60
36 meses	19,93	38,12	-18,20	4,23
48 meses	26,67	58,91	-32,24	4,49
60 meses	31,43	72,23	-40,81	6,17
Desde 29/12/2017	56,18	100,56	-44,38	6,29

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

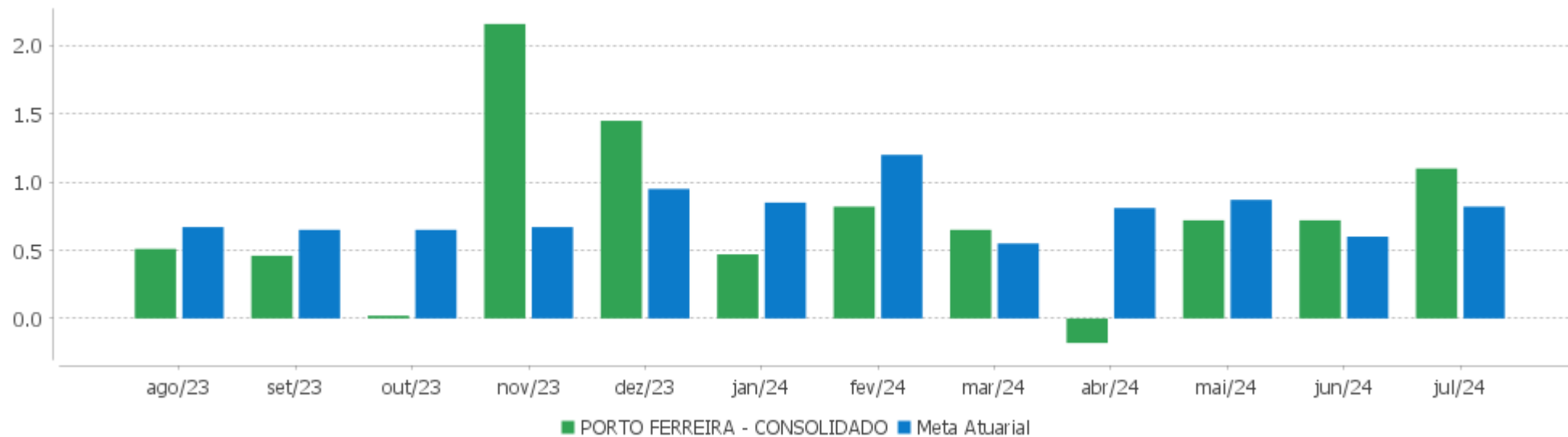


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO % do CDI	-0,44 -48,96	-3,56 -57,59	-1,58 -62,03	-3,32 -64,28	-5,03 -43,68	-7,63 -28,62	-63,39 -164,43
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,89 -0,02	4,13 -0,13	2,31 -0,06	3,45 -0,12	7,93 -0,23	20,02 -0,35	31,84 -0,63
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IDKA 2 p.p.	0,76 0,01	3,90 -0,08	2,08 0,08	3,17 0,01	7,92 -0,20	19,47 -0,05	30,83 -0,78
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,96 0,58	3,35 0,47	1,85 0,79	2,67 0,23	7,47 2,97	23,28 14,61	29,89 10,28
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,73 -0,02	3,70 -0,28	1,96 -0,05	2,95 -0,20	7,87 -0,25	19,26 -0,27	30,48 -1,13
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA % do CDI	0,90 99,44	2,88 46,70	1,92 75,36	2,32 45,00	6,18 53,73	19,43 72,89	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	1,04 0,66	4,91 2,04	2,15 1,10	4,03 1,59	10,06 5,56	25,62 16,95	33,23 13,62
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,91 100,85	5,96 96,50	2,50 98,19	4,96 96,18	11,19 97,26	26,26 98,50	38,30 99,34
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO % do CDI	0,91 100,00	6,15 99,59	2,54 99,56	5,14 99,61	11,45 99,49	26,56 99,63	38,53 99,95
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI % do CDI	0,89 98,57	6,10 98,70	2,51 98,54	5,09 98,65	11,35 98,62	26,35 98,87	38,17 99,02
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA Var. IPCA p.p.	0,88 0,50	2,80 -0,07	1,43 0,37	2,32 -0,13	7,03 2,53	21,01 12,34	32,68 13,07
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I % do CDI	-0,48 -52,77	-8,38 -135,71	-2,47 -96,69	-5,30 -102,65	-9,53 -82,78	199.816.685,66 749.577.347,63	199.816.685,66 518.313.332,10
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do CDI	-0,36 -39,65	-3,11 -50,41	-1,23 -48,05	-2,49 -48,18	-5,09 -44,19	-5,94 -22,30	-2,20 -5,71
BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,00 109,74	6,74 109,10	2,74 107,26	5,59 108,36	12,51 108,72	28,26 106,00	41,22 106,93
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,97 107,18	6,26 101,42	2,62 102,65	5,25 101,68	11,61 100,84	26,75 100,36	39,03 101,23
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,08 -0,01	0,75 -0,22	2,29 -0,16	1,25 -0,18	4,14 -0,24	19,96 -0,56	23,52 -0,91
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	0,45	0,51	0,40	0,30	1,96	7,77	7,35

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,65	-0,46	-2,05	-1,12	-2,42	-12,74	-17,08
XP INVESTOR FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	5,17 2,15	-5,98 -1,11	2,50 1,13	-3,64 -3,57	4,63 -0,05	19,38 -4,36	7,97 3,16
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	2,47 -0,55	-8,91 -4,04	1,38 0,01	-2,62 -2,54	-0,25 -4,93	11,41 -12,33	-2,03 -6,83
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	0,51 0,22	40,23 -1,25	20,99 -0,40	34,11 -0,91	49,78 -2,21	60,78 -4,23	43,02 -4,42
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V % do CDI	-0,39 -43,36	-4,32 -69,95	-1,15 -44,91	-2,24 -43,48	-6,04 -52,49	-11,98 -44,96	-16,84 -43,68
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	1,38 -1,63	18,31 -17,10	10,67 -9,39	16,35 -13,92	26,54 -17,16	52,86 6,95	54,59 15,69
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,00 -0,92	0,00 -6,43	0,00 -2,56	0,00 -5,45	0,00 -10,74	0,00 -22,05	0,00 -42,36
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO Var. IFIX p.p.	0,13 -0,39	-3,68 -5,29	-3,95 -3,45	-3,82 -4,75	-6,32 -11,56	-0,13 -19,70	4,00 -15,14
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO Var. IPCA + 4,96% p.p.	1,10 0,27	4,37 -1,45	2,55 0,25	3,88 -1,05	9,25 -0,41	20,87 1,20	19,93 -18,30
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	D+0	D+0	D+0	D+0		0,10
BRDESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATEGIA	Não se aplica	Não se aplica				
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	Não se aplica	Não se aplica				
INCENTIVO FIDC MULTISETORIAL I	Não se aplica	Não se aplica				
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,00
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC	D+0	D+0				
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	D+0	D+0	D+1008 du	D+1009 du	PERÍODO SEMESTRAL, C /VENCIMENTO NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DE	0,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
					DEZEMBRO E JUNHO.	
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+0	D+0	D+0 ou D+1080 (isento de taxa de resgate)	D+1 du ou D+1081 (isento de taxa de resgate)		1,40
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
XP INVESTOR FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du	Para informações adicionais, vide o Regulamento	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,94	5,49	2,37	4,62	10,81	26,14	36,37	39,08	46,74
IRF-M 1+	1,55	1,77	1,44	1,17	7,38	27,10	28,37	24,09	39,00
IRF-M TOTAL	1,34	2,87	1,71	2,19	8,37	26,19	30,49	28,67	41,29
IMA-B 5	0,91	4,27	2,37	3,56	8,16	20,37	32,46	39,16	51,45
IMA-B 5+	3,24	-1,97	2,52	-0,51	1,03	20,60	16,72	17,12	26,27
IMA-B TOTAL	2,09	0,97	2,45	1,43	4,38	20,51	24,43	27,57	37,98
IMA-GERAL TOTAL	1,36	3,81	2,36	3,33	8,64	24,49	31,89	34,10	43,92
IDKA 2	0,75	3,98	2,01	3,15	8,12	19,52	31,61	39,35	51,45
IDKA 20	6,19	-6,65	2,88	-3,43	-3,72	23,96	4,78	3,52	8,64
CDI	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	3,02	-4,87	1,37	-0,08	4,68	23,74	4,80	24,04	25,38
IBRX 100	2,90	-4,51	1,13	0,00	5,15	22,39	2,42	23,65	26,33
IBRX 50	3,15	-3,17	1,57	1,02	6,82	24,69	4,81	28,10	28,40
SMALL CAP	1,49	-13,59	-2,33	-7,53	-13,35	1,79	-31,36	-17,55	-11,07
Índice Consumo - ICON	2,01	-12,31	0,40	-4,34	-15,32	-14,69	-47,16	-45,60	-38,99
Índice Dividendos - IDIV	1,89	-1,58	2,90	2,00	11,06	31,85	31,21	49,86	55,10

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,01	35,40	20,06	30,27	43,70	45,91	38,90	83,71	178,66

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	0,52	1,61	-0,50	0,94	5,24	19,57	19,14	23,11	26,52

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,40	30,98	17,81	27,34	37,49	39,32	24,28	60,53	133,51

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,38	2,87	1,05	2,44	4,50	8,67	19,61	30,37	33,38
INPC	0,26	2,95	0,97	2,36	4,06	7,73	18,64	30,33	33,84
IGPM	0,61	1,71	2,33	1,64	3,82	-4,19	5,46	41,14	54,22
SELIC	0,91	6,18	2,55	5,16	11,51	26,66	38,55	41,92	47,93

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,74	5,25	2,07	4,46	8,66	17,50	34,49	52,40	62,17
IPCA + 5,00%	0,83	5,84	2,31	4,95	9,70	19,76	38,39	58,31	70,09
IPCA + 5,50%	0,87	6,14	2,44	5,20	10,22	20,90	40,36	61,34	74,17
IPCA + 5,89%	0,91	6,37	2,53	5,39	10,63	21,79	41,92	63,72	77,40
IPCA + 6,00%	0,92	6,43	2,56	5,45	10,74	22,05	42,36	64,40	78,32
INPC + 4,00%	0,62	5,33	1,98	4,37	8,21	16,49	33,39	52,35	62,74
INPC + 6,00%	0,79	6,50	2,48	5,36	10,28	20,99	41,20	64,35	78,94

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
91	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	137.233,58	24.343,09343900	5,6374750000
84	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	149.321,92	0,00	26.487,37599700	5,6374750000
90	02/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	20.016,25	0,00	3.548,96665200	5,6400220000
83	02/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	38.888,11	0,00	6.895,02806900	5,6400220000
76	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	193.404,62	0,00	34.246,22910900	5,6474720000
89	10/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	15.038,21	0,00	2.659,64923800	5,6542080000
82	10/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	9.084,85	0,00	1.606,74138600	5,6542080000
88	11/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.028,44	0,00	712,18570800	5,6564460000
81	11/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.785,42	0,00	1.199,59069700	5,6564460000
87	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	350.000,00	61.564,57043700	5,6850880000
80	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	300.000,00	52.769,63154300	5,6850880000
86	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	26.022,12	0,00	4.575,47789300	5,6873010000
85	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	259.000,00	45.540,05470300	5,6873010000
77	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	37.000,00	0,00	6.505,72213400	5,6873010000
78	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	320.000,00	56.265,70479100	5,6873010000
79	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	27.413,20	0,00	4.820,07194600	5,6873010000
Total			527.003,14	1.366.233,58		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 1.915.273,66

Value-At-Risk: 0,84%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,98	0,54	5,00	0,41	-0,01	0,90	202.585.488,64	89,34
Artigo 8º	13,60	7,00	20,00	0,40	0,24	4,18	14.680.370,86	6,47
Artigo 9º	21,18	7,37	20,00	-0,01	-0,02	0,51	4.170.278,99	1,84
Artigo 10º	13,54	5,65	20,00	0,04	NaN	NaN	3.140.029,92	1,38
Artigo 11º	0,44	0,18	20,00	0,00	-1,75	0,13	2.187.035,51	0,96
PORTO FERREIRA - CONSOLIDADO		0,84		0,84			226.763.203,92	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,54%

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,92	0,43	0,01	0,43	0,14	1,04	4.096.897,58	1,81
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI	1,98	1,12	0,04	0,19	-0,07	0,76	9.040.073,81	3,99
BB RF REFERENCIADO DI TITULOS PUBLICOS FI LONGO PRAZO	0,00	0,01	0,00	0,01	0,01	0,91	19.719.525,83	8,70
FI CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	2,86	1,65	0,18	1,65	-0,00	0,90	30.235.723,06	13,33
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,17	1,22	0,04	0,20	-0,08	0,73	9.042.002,85	3,99
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	1,01	0,06	0,01	-0,01	0,89	16.264.961,35	7,17
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,06	0,07	0,02	0,07	0,14	0,91	81.097.158,66	35,76
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,35	0,73	0,01	0,73	0,04	0,96	5.177.824,27	2,28
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIF CIC RESP LIMITADA	1,18	0,90	0,01	0,90	-0,02	0,88	2.541.345,44	1,12
SANTANDER RF REFERENCIADO DI TP PREMIUM FIC FI	0,01	0,01	-0,00	0,01	-1,76	0,89	8.265.321,37	3,64
Sub-total	0,90	0,52	0,36		-0,01	0,90	185.480.834,22	81,79

Artigo 7º III, Alínea a

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,08	0,02	0,00	0,02	0,82	0,97	7.355,87	0,00
BRADERCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11	0,04	-0,00	0,04	0,78	1,00	4.640.377,79	2,05
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,73	2,24	0,04	0,08	0,25	2,08	5.096.332,75	2,25
LME REC IMA B FI RENDA FIXA	1,02	0,56	0,01	1,78	-0,45	0,45	4.938.636,68	2,18
Sub-total	1,96	0,94	0,05		0,14	1,18	14.682.703,09	6,47

Artigo 7º V, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL I	1,59	0,20	0,00	0,20	-0,87	-0,48	367.607,60	0,16
LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	1,19	0,10	0,00	0,10	-1,06	-0,36	1.173.736,59	0,52
Sub-total	1,29	0,12	0,00		-1,01	-0,39	1.541.344,19	0,68

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PIATÃ FI Rf LP PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,45	0,50	-0,00	0,50	-2,98	-0,44	880.607,14	0,39
Sub-total	0,45	0,50	-0,00		-2,98	-0,44	880.607,14	0,39

Renda Variável

Value-At-Risk: 7,00%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	10,59	5,54	0,11	1,52	0,15	2,47	5.276.970,20	2,33
XP INVESTOR FI DE ACOES	16,11	8,13	0,29	4,11	0,26	5,17	9.403.400,66	4,15
Sub-total	13,60	7,00	0,40		0,24	4,18	14.680.370,86	6,47

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 7,37%

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	21,18	7,37	-0,01	1,06	-0,02	0,51	4.170.278,99	1,84

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Sub-total	21,18	7,37	-0,01		-0,02	0,51	4.170.278,99	1,84

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 5,65%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,61	5,68	0,04	5,37	0,03	1,38	3.124.044,51	1,38
LEME FIC FI MULTIMERCADO CREDITO PRIVADO V	0,00	0,00	-0,00	0,00	-3.293,91	-0,39	15.985,41	0,01
Sub-total	13,54	5,65	0,04		0,03	1,37	3.140.029,92	1,38

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
GERACAO DE ENERGIA FIP MULTISTRATEGIA	0,00	NaN	0,00	NaN	0,00	0,00	0,00	0,00
Sub-total	0,00	NaN	0,00		0,00	NaN	0,00	0,00

Fundos Imobiliários

Value-At-Risk: 0,18%

Artigo 11º

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
HAZ FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO	0,44	0,18	0,00	2,41	-1,75	0,13	2.187.035,51	0,96
Sub-total	0,44	0,18	0,00		-1,75	0,13	2.187.035,51	0,96

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

- Referente ao mês de julho de 2024, cabe ressaltar que:

- REGULAR POR ANÁLISE - DAIR;
- QUANTO AO DESENQUADRAMENTO EM TELA, CUMPRE-NOS INFORMAR QUE TRATA-SE DE UMA APLICAÇÃO REALIZADA EM 31/03/2010, ANTES MESMO DA RESOLUÇÃO 3922/2010 (O QUE JUSTIFICA O PERCENTUAL APLICADO EM RELAÇÃO AO PL DO FUNDO), EM UM FUNDO FECHADO COM CARÊNCIA PARA A LIQUIDAÇÃO DA OPERAÇÃO. CARÊNCIA ENCERRADA EM DEZEMBRO DE 2019, PORÉM O MESMO ENCONTRA-SE FECHADO PARA RESGATES DESDE 06/07/2017. O FUNDO ENCONTRA-SE ATUALMENTE EM RECUPERAÇÃO DE CRÉDITOS, O QUE JUSTIFICA A VALORIZAÇÃO DAS COTAS, BEM COMO, O DESENQUADRAMENTO EM DISCUSSÃO.